

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/11/2020

Retorno e Meta Atuarial - Novembro de 2020

RENTA FIXA

Ativo			Rentabilidade							Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN/	Rentabilidade	Valor do Mês		
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 25.502.696,76	0,22%	R\$ 1.362.030,94	R\$ 884.650,11	R\$ -	R\$ 54.289,66	R\$ 26.034.367,25	Art. 7º, I, b	
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 81.960.482,92	0,14%	R\$ 106.165.923,49	R\$ 187.395.221,64	R\$ -	R\$ 95.021,15	R\$ 826.205,92		
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	R\$ 110.927.232,87	2,49%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.766.664,85	R\$ 113.693.897,72		
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	R\$ 159.838.542,57	2,57%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.100.447,07	R\$ 163.938.989,64		
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA	R\$ 70.122.573,85	1,30%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 915.079,87	R\$ 71.037.653,72		
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA	R\$ 144.391.873,63	2,38%	R\$ -	R\$ 17.000.000,00	R\$ -	R\$ 3.432.769,57	R\$ 130.824.643,20		
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF	R\$ 39.344.259,13	0,49%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 192.775,21	R\$ 39.537.034,34		
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 197.441.151,25	0,43%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 855.895,69	R\$ 198.297.046,94		
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA	R\$ 199.131.799,36	0,82%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.632.844,43	R\$ 200.764.643,79		
10.979.025/0001-32	152 - SANTANDER FI IRF-M 1 TP RF	R\$ 117.904.857,05	0,02%	R\$ -	R\$ 118.020.556,53	R\$ -	R\$ 115.699,48	R\$ (0,00)		
SUBTOTAL		R\$ 1.146.565.469,39		R\$ 107.527.954,43	R\$ 323.300.428,28	R\$ -	R\$ 14.161.486,98	R\$ 944.954.482,52		
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 7.363.691,14	0,60%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 44.426,29	R\$ 7.408.117,43	Art. 7º IV, a	
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAM	R\$ 325.267.072,16	0,09%	R\$ -	R\$ 75.000.000,00	R\$ -	R\$ 300.424,74	R\$ 250.567.496,90		
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 60.636.712,87	0,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 83.095,26	R\$ 60.719.808,13		
SUBTOTAL		R\$ 393.267.476,17		R\$ -	R\$ 75.000.000,00	R\$ -	R\$ 427.946,29	R\$ 318.695.422,46		
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (8.467.284,90)	-0,31%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (26.448,25)	R\$ (8.493.733,15)	Art. 7º, VII, a	
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	R\$ 24.955.813,84	0,07%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 16.830,79	R\$ 24.972.644,63		
SUBTOTAL		R\$ 16.488.528,94		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (9.617,46)	R\$ 16.478.911,48		
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 1.556.321.474,50		R\$ 107.527.954,43	R\$ 398.300.428,28	R\$ -	R\$ 14.579.815,81	R\$ 1.280.128.816,46		



Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/11/2020

Retorno e Meta Atuarial - Novembro de 2020

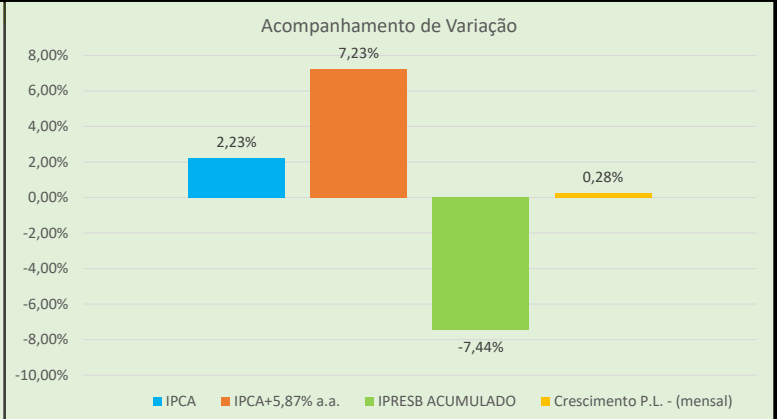
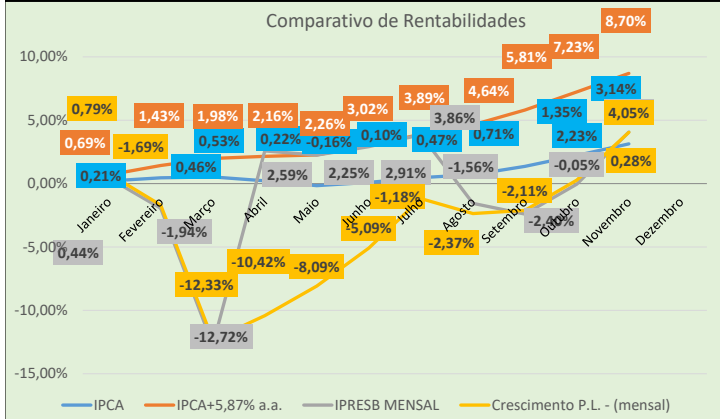
RENDA VARIÁVEL										
Ativo			Rentabilidade							
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	Enquad.	
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	R\$ 76.832.790,53	11,61%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 8.918.396,44	R\$ 85.751.186,97	Art. 8º, II, a	
23.731.629/0001-07	133 - ITÁU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX F	R\$ 64.557.635,78	13,92%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 8.986.693,19	R\$ 73.544.328,97		
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 94.386.691,13	11,89%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 11.219.142,27	R\$ 105.605.833,40		
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 127.429.176,03	13,58%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 17.300.438,16	R\$ 144.729.614,19		
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIO	R\$ 35.316.592,75	11,65%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.113.327,03	R\$ 39.429.919,78		
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONA	R\$ 4.822.288,78	8,68%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 418.557,03	R\$ 5.240.845,81		
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 4.641.958,38	13,89%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 644.966,14	R\$ 5.286.924,52		
29.549.642/0001-26	157 - SANTANDER SELEÇÃO 30 AÇÕES FIC FI	R\$ -	2,61%	R\$ 88.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.300.194,76	R\$ 90.300.194,76		
SUBTOTAL		R\$ 407.987.133,38		R\$ 88.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 53.901.715,02	R\$ 549.888.848,40		
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	R\$ 38.424.791,15	4,02%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.543.384,69	R\$ 39.968.175,84	Art. 8º, III	
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVE	R\$ 16.831.913,13	1,01%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 170.281,23	R\$ 17.002.194,36		
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	R\$ 5.593.818,87	0,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.211,46	R\$ 5.598.030,33		
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 42.736.275,22	10,80%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.616.949,67	R\$ 47.353.224,89		
35.637.151/0001-30	151 - ICATU VANGUARDA LONG BIASED FIM	R\$ 929.149,04	10,72%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 99.595,42	R\$ 1.028.744,46		
SUBTOTAL		R\$ 104.515.947,41		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.434.422,47	R\$ 110.950.369,88		
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.442.783,91	-0,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (11.554,10)	R\$ 9.431.229,81	Art. 8º, IV, a	
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	R\$ 1.634.113,40	-8,79%	R\$ -	R\$ 1.475.539,09	R\$ -	R\$ (143.693,00)	R\$ 14.881,31		
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FI	R\$ 10.570.437,98	-0,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (12.918,44)	R\$ 10.557.519,54		
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.106.095,15	-0,17%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (25.410,60)	R\$ 15.080.684,55		
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 15.063.443,81	20,86%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 3.141.539,12	R\$ 18.204.982,93		
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTI	R\$ 5.491.202,52	1,16%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 63.578,26	R\$ 5.554.780,78		
SUBTOTAL		R\$ 57.308.076,77		R\$ -	R\$ 1.475.539,09	R\$ -	R\$ 3.011.541,24	R\$ 58.844.078,92		
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	R\$ 350.330,00	-5,79%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (20.290,00)	R\$ 330.040,00	Art. 8º, IV, b	
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 1.526.823,52	3,32%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 50.718,07	R\$ 1.381.046,40		
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 14.916.614,83	0,25%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 37.879,58	R\$ 14.884.500,31		
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	R\$ 16.176.997,47	-0,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (23.276,97)	R\$ 16.153.720,50		
SUBTOTAL		R\$ 32.970.765,82		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 45.030,68	R\$ 32.749.307,21		
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQ	R\$ -	8,19%	R\$ 30.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.457.994,48	R\$ 32.457.994,48	Art. 9º, II	
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES C	R\$ -	-0,48%	R\$ 30.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ (142.692,28)	R\$ 29.857.307,72		
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ -	9,14%	R\$ 64.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.847.225,42	R\$ 69.847.225,42		
SUBTOTAL		R\$ -		R\$ 124.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 8.162.527,62	R\$ 132.162.527,62		
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NI	R\$ -	2,18%	R\$ 80.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.742.514,82	R\$ 81.742.514,82	Art. 9º, III	
SUBTOTAL		R\$ -		R\$ 80.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.742.514,82	R\$ 81.742.514,82		
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 602.781.923,38		R\$ 292.000.000,00	R\$ 1.475.539,09	R\$ -	R\$ 73.297.751,85	R\$ 966.337.646,85		
CONTA CORRENTE										
Número	Descrição	Saldo Ant						Saldo Atual		
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00						R\$ 100,00		
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 10.000,00						R\$ 10.000,00		
33888-1	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03	R\$ -						R\$ -		
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	R\$ 5.341,83	0,00%					R\$ 81,03		
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	R\$ 47,75						R\$ 47,75		
98300-4	Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	R\$ 78,05						R\$ 78,05		
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	R\$ 100,06						R\$ 100,06		
SUBTOTAL		R\$ 15.667,69						R\$ 10.406,89		
Total de Recursos (Mês Anterior)		R\$ 2.159.119.065,57	CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE OUTUBRO/2020							
Total de Recursos (Mês Atual)		R\$ 2.246.476.870,20	4,05%							

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira	Limites por Enquadramento / Política	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	42,06%	100% / 44%	<ul style="list-style-type: none"> Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional Fundo RF - Geral Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios Fundo RV - Ações Geral Fundo RV - Multimercado Fundo RV - FIP - Participações Fundo RV - FII - Imobiliário Fundo RV - Investimentos no Exterior Fundo RV - Investimentos no Exterior
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	14,19%	40% / 14%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,73%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	24,48%	20% / 21%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	4,94%	20% / 5%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,62%	20% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,46%	20% / 2%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	5,88%	10% / 6%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	3,64%	10% / 4%	

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2020							
Período	Recursos	Contribuição	Rentabilidade Mês	Crescimento P.L. - (mensal)	Rendimento Mensal	Rend. Médio Trimestral	Rendim. Semestral
Janeiro	R\$ 2.285.100.608,11	R\$ 15.916.944,65	R\$ 10.000.854,69	0,79%	0,44%	-4,74%	-1,08%
Fevereiro	R\$ 2.246.388.562,38	R\$ 15.848.374,30	R\$ (44.385.033,04)	-1,69%	-1,94%		
Março	R\$ 1.969.668.286,36	R\$ 15.917.531,29	R\$ (285.736.404,74)	-12,33%	-12,72%		
Abril	R\$ 2.031.066.499,43	R\$ 15.831.484,26	R\$ 50.920.404,78	-10,42%	2,59%	2,58%	
Mai	R\$ 2.083.822.283,35	R\$ 15.796.467,75	R\$ 45.791.587,96	-8,09%	2,25%		
Junho	R\$ 2.151.843.412,66	R\$ 15.586.723,63	R\$ 60.672.098,57	-5,09%	2,91%	-0,03%	
Julho	R\$ 2.240.528.869,77	R\$ 15.701.143,37	R\$ 83.157.659,02	-1,18%	3,86%		
Agosto	R\$ 2.213.587.909,12	R\$ 15.809.176,58	R\$ (34.900.241,18)	-2,37%	-1,56%		
Setembro	R\$ 2.152.200.580,06	R\$ 16.533.757,44	R\$ (53.174.395,71)	-2,11%	-2,40%	-	
Outubro	R\$ 2.159.119.065,57	R\$ 15.830.228,49	R\$ (1.029.254,36)	0,28%	-0,05%		
Novembro	R\$ 2.246.505.407,97	R\$ 31.465.853,79	R\$ 87.877.567,66	4,05%	4,07%		
Dezembro							

DESEMPENHO E INDICADORES							
MÊS	IPCA		IPCA+5,87% a.a.		IPRESB MENSAL		
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	RENTAB. MÉDIA
Janeiro	0,21%	0,21%	0,69%	0,69%	0,44%	0,44%	0,44%
Fevereiro	0,25%	0,46%	0,73%	1,43%	-1,94%	-1,51%	-0,75%
Março	0,07%	0,53%	0,55%	1,98%	-12,72%	-14,04%	-4,74%
Abril	-0,31%	0,22%	0,17%	2,16%	2,59%	-11,82%	-2,91%
Mai	-0,38%	-0,16%	0,10%	2,26%	2,25%	-9,83%	-1,88%
Junho	0,26%	0,10%	0,74%	3,02%	2,91%	-7,20%	-1,08%
Julho	0,37%	0,47%	0,85%	3,89%	3,86%	-3,62%	-0,37%
Agosto	0,24%	0,71%	0,72%	4,64%	-1,56%	-5,12%	-0,52%
Setembro	0,64%	1,35%	1,12%	5,81%	-2,40%	-7,40%	-0,73%
Outubro	0,86%	2,23%	1,34%	7,23%	-0,05%	-7,44%	-0,66%
Novembro	0,89%	3,14%	1,37%	8,70%	4,07%	-3,67%	-0,23%
Dezembro							

INDICADORES DE REFERÊNCIA				
INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)	
IBOVESPA	16,21%	-5,30%	-	
CDI	0,15%	2,50%	-	
IPCA+5,87% a.a.	1,37%	8,70%	7,50%	



RESUMO DAS INFORMAÇÕES	
RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2020	R\$ 2.267.267.269,68
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.246.476.870,20
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2020	R\$ 190.237.685,55
TOTAL DE RENDIMENTOS 2020	R\$ (80.805.156,35)
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	-0,92%
META ATUARIAL 1,63% (PROJEÇÃO BOLETIM FOCUS, 03/07)+ 5,87% DRAA	7,50%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2020	-3,67%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2020	-48,98%

Obs: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Novembro/2020.